

Fecha de Publicación: 5 de Enero de 2007
Fecha de Información: 3 de Enero de 2007¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$279,3 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 4,2%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	67,6	31,5	31,5	67,6	99,1
15-35	110,5	76,9	44,9	78,5	155,4
36-60	3,0	1,1	1,1	3,0	4,1
61-90	0,8	3,4	3,4	0,8	4,3
91-180	0,3	5,2	5,2	0,3	5,5
>180	1,3	9,6	9,6	1,3	10,9
Total	183,6	127,7	95,7	151,6	279,3

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	3,6 %	6,7 %
15-35	2,7 %	2,7 %
36-60	3,4 %	3,1 %
61-90	3,2 %	3,3 %
91-180	3,1 %	3,2 %
>180	2,9 %	3,4 %
Total	3,1 %	4,2 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	1 al 5 de Enero				8 al 12 de Enero				15 al 19 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	56	16	601	527	155	46	690	619	85	24	886	800
Real	16	56	310	384	46	155	463	534	24	85	613	698
Total	72	72	911	911	202	202	1153	1153	109	109	1498	1498

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 4 de enero se presenta la proyección de vencimientos.